

(上接B013版)

注册地址:四川省成都市陕西街239号  
办公地址:四川省成都市陕西街239号  
法定代表人:杨柳洋  
客户服务电话:028-00096584  
网址:www.hx168.com.cn  
(39) 上海天天基金销售有限公司  
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层  
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼  
法定代表人:其实  
客户服务电话:400-1818-188  
网址:www.1234567.com.cn  
(40) 浙江同花顺基金销售有限公司  
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室  
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼  
法定代表人:凌顺平  
客户服务电话:0571-88920897 4008-773-772  
网址:www.5ifund.com  
(41) 上海好买基金销售有限公司  
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室  
办公地址:上海浦东南路118号鄂尔多斯大厦903-906室  
法定代表人:杨文斌  
客户服务电话:400-700-0665  
网址:www.ehowbuy.com  
(42) 北京增财基金销售有限公司  
注册地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号  
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室  
法定代表人:罗细安  
客户服务电话:400-001-8811  
网址:www.zcvc.com.cn  
(43) 深圳众禄基金销售有限公司  
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元  
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J单元  
法定代表人:薛峰  
客户服务电话:4006-788-887  
网址:www.lf2fund.cn;www.jmmw.com  
(44) 杭州数米基金销售有限公司  
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号  
办公地址:杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈柏青  
客户服务电话:4000-766-123  
网址:www.fund123.cn  
(45) 深圳腾元基金销售有限公司  
注册地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)单元  
办公地址:深圳市福田区金田路2028号 皇岗商务中心406-407  
法定代表人:卓砾疆  
客户服务电话:400-700-0665  
网址:www.tenyanfund.com  
(46) 上海长量基金销售投资顾问有限公司  
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号 2 檐 220 室  
办公地址:上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层  
法定代表人:张跃伟  
客户服务电话:400-089-1289  
网址:www.erichfund.com  
(47) 一路财富(北京)信息科技有限公司  
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702  
办公地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702  
法定代表人:吴雪秀  
客户服务电话:400-001-1566  
网址:www.yilucaifu.com  
(48) 北京晟视天下投资管理有限公司  
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层  
法定代表人:蒋煜  
客户服务电话:400-818-8866  
联系人:徐长征、林凌  
电话:010-58170943,010-58170918  
网址:www.shengshiview.com.cn  
(49) 北京景泰财富投资管理有限公司  
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
法定代表人:赵春荣  
客户服务电话:400-678-5095  
联系人:魏  
电话:010-57418829  
网址:www.niuj.net  
(50) 宜信普惠投资顾问(北京)有限公司  
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809  
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809  
法定代表人:沈伟桦  
客户服务电话:400-6099-200  
联系人:程刚  
电话:010-52856713  
网址:www.yixinfund.com  
(51) 北京京瑞华投资咨询有限公司  
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室  
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A座3层303室  
法定代表人:王岩  
客户服务电话:400-819-9868  
电话:010-59200999  
传真:010-59200800  
网址:www.tdhyfund.com  
(52) 中经北证(北京)资产管理有限公司  
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  
办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层  
法定代表人:徐福星  
客户服务电话:010-68998820  
联系人:陈莹莹  
电话:010-68998820-8306  
网址:www.dzfunds.com  
(53) 大同证券经纪有限责任公司  
注册地址:山西省大同市迎宾街15号桐城中央21层  
办公地址:山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心A 座12、13层  
法定代表人:董祥  
客户服务电话:4007121212  
网址:www.dtsbc.com.cn  
(54) 上海汇付金融服务有限公司  
注册地址:上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室  
办公地址:上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼  
法定代表人:张晶  
联系人:周丹  
电话:021-33323999  
传真:021-33323993  
客户服务电话:400-820-2819  
手机客户端:天天盈基金  
网址:fund.bundtrade.com  
(55) 上海利得基金销售有限公司  
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室  
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号12楼  
法定代表人:赵继伟  
联系人:赵洁然  
联系人电话:021-50583533  
传真:021-50585353  
客户服务电话:  
网址:www.leadbank.com.cn  
(56) 浙江金观诚财富管理有限公司  
注册地址:杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦1幢10楼1001室  
办公地址:杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦1幢10楼1001室  
法定代表人:陈峰  
联系人:周立枫  
联系人电话:0571-88337888  
客户服务电话:400-068-0058  
网址:www.jincheng-fund.com  
(57) 深圳市新三德证券投资咨询责任公司  
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#  
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#  
法定代表人:马令海  
客户服务电话:0755-88399099  
网址:8.jif.com.cn  
(58) 第一创业证券股份有限公司  
注册地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层  
办公地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层  
法定代表人:刘学民  
客户服务电话:400-888-1888  
网址:www.firstcapital.com.cn  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并及时公告。

(b) E类份额的发售机构  
基金管理人指定的互联网交易平台。  
(d) C类份额的发售机构  
本公司位于北京、上海、广州、深圳、成都的直销中心,及本公司的直销网上交易系统。  
(1) 深圳直销中心  
办公地址:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层  
邮政编码:518048  
电话:0755-83026603  
传真:0755-83026677  
联系人:刘倩云  
(2) 北京直销网点  
办公地址:北京市朝阳区光华路甲14号诺安大厦8-9层  
邮政编码:100020  
电话:010-59027811  
传真:010-59027890  
联系人:孟佳  
(3) 上海直销网点  
办公地址:上海市浦东新区世纪大道210号21世纪中心大厦903室  
邮政编码:200120  
电话:021-68824617  
传真:021-68362099  
联系人:温乐珣  
(4) 广州直销网点  
办公地址:广州市珠江新城华夏路10号富力中心2908  
邮政编码:510623  
电话:020-38928980  
传真:020-38928980  
联系人:黄怡珊  
(5) 西部营销中心  
办公地址:成都市锦江区下东大街216号喜年广场2407  
邮政编码:610021  
电话:028-86586052  
传真:028-86586055  
联系人:裴兰  
(6) 基金管理人网上直销系统  
网址:www.lionfund.com.cn  
客服电话:400-888-8998  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并及时公告。

(二) 注册登记机构  
名称:诺安基金管理有限公司  
住所:深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19—20层  
法定代表人:秦维舟  
电话:0755-83026688  
传真:0755-83026677  
(三) 出具法律意见书的律师事务所  
名称:北京融合中鸿律师事务所  
住所:北京市东城区建国门内大街7号光华长安大厦2座1908—1911室  
法定代表人/负责人:付朝晖  
电话:010-65178866  
传真:010-65180276  
经办律师:虞芳、高平均  
(四) 审计基金财产的会计师事务所  
名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市延安东路222号外滩中心30楼  
执行事务合伙人:卢伯卿  
电话:021-61418888  
传真:021-63500003  
联系人:余志亮  
经办注册会计师:王明静、洪锐明  
四、基金名称  
诺安天天宝货币市场基金  
五、基金类型  
契约性开放式  
六、基金的投资目标  
在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。  
七、基金的投资方向  
本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括:  
1. 现金;  
2. 通知存款;  
3. 短期融资券(包括超级短期融资券);  
4. 1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单;  
5. 期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购;  
6. 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券;  
7. 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券;  
8. 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据;  
9. 期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);  
10. 中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。  
如果法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。  
**八、基金的投资策略**  
本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。  
1. 利率预期策略  
影响利率的因素很多,影响短期利率变动的因素更多,运行方式也更为复杂。基金管理人将重点考察以下两个因素:  
(1) 中央银行、财政部等国家宏观经济管理部门的政策意图。政府对金融市场的运行影响非常深远,国家宏观经济管理部门尤其是中央银行对经济运行形势的判断及采取的应对政策是影响利率走势的关键因素之一。  
(2) 短期资金供求变化。短期资金市场参与者的头寸宽紧程度是短期利率变动的重要主导力量。短期利率随短期资金供求变化呈一定的季节波动形态。具体而言,基金管理人将持续跟踪反映国民经济变化的宏观经济指标,对国家经济政策进行深入分析,进而对短期利率的变动态势做出及时反应。重点关注的宏观经济指标包括:国家经济管理部门政策、预期物价指数、相关市场价格供求关系等。  
2. 期限配置策略  
在短期利率期限结构分析的基础上,根据对投资对象流动性和收益性的动态考察,构建合理期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看,一般来说,预期利率上涨时,将适当缩短组合的平均期限,预期利率下降时,将在法律规定的范围内适当延长组合的平均剩余期限。  
3. 预期收益率配置策略  
在短期利率期限结构分析和品种深入分析的基础上,进行品种合理配置。预期利率上涨时,可以增加回购资产的比重,适度降低债券资产的比重,预期

利率下降,将降低回购资产的比重,增加债券资产的比重。

4. 银行定期存款及大额存单投资策略  
银行定期存款及大额存单是本基金的主要投资对象,因此,银行定期存款及大额存单的投资将是本基金关注的重点之一。具体而言,在组合投资过程中,本基金将在综合考虑成本收益的基础上,尽可能的扩大交易对手方的覆盖范围,通过对这些银行广泛、耐心而细致的询价,挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行定期存款及大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及大额存单资产的流动性。

5. 套利策略  
在久期控制的基础上,本基金管理人将对货币市场的各个细分市场进行深入研究分析,在严格控制风险和保障流动性的前提下,寻找跨市场、跨期限、跨品种的套利投资机会,以期获得更高的收益。当然,由于交易机制的限制,目前挖掘套利投资机会的投资方法主要是用风险相当,但收益更高的品种替代收益较低的品种,或者用收益相当,风险较低的品种替代风险较高的品种。

6. 流动性管理策略  
流动性好是货币市场基金的重要特征之一。在日常的投资管理过程中,本基金将紧密关注申购/赎回现金流变化情况。季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。

具体而言,本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、银行定期存款提前支取,持有高流动性品种,正向回购,降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,也可采用持续滚动投资方法,通过对回购或债券的到期日进行均衡等量配置,以满足日常的基金资产变现需求。

九、基金的业绩比较标准

活期存款利率(税后)。

十、基金的风险收益特征

本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至日为2015年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	180,938,971.94	41.91
	其中:债券	180,938,971.94	41.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	206,981,070.47	47.96
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	337,696.81	0.08
4	其他各项资产	43,432,763.99	10.06
5	合计	431,690,492.61	100.00

2、报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.39
	其中:买断式回购融资	-
2	报告期末债券回购融资余额	-
	其中:买断式回购融资	-

注:本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3、报告期基金投资组合平均剩余期限

(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期内投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

报告期内组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

(2) 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	52.96
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-
2	30天(含)-60天	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-
3	60天(含)-90天	4.67
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-
4	90天(含)-180天	13.98
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-
5	180天(含)-397天(含)	23.30
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-
6	397天以上	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-
7	合计	94.81

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例
----	------	------	-----------